

BAB III

METODE PENELITIAN

A. Jenis Penelitian

Penelitian ini menggunakan penelitian asosiatif yaitu yang bertujuan untuk mengetahui pengaruh atau hubungan antara dua variabel atau lebih. Penelitian ini menggunakan analisis dan jenis data bersifat kuantitatif tentang sejumlah perusahaan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI) selama periode 2011-2015.

B. Definisi Operasional Variabel

1. Variabel dependen (Y)

Volume perdagangan saham adalah banyaknya lembar saham suatu perusahaan yang diperjualbelikan di pasar modal. Dasar perhitungan ini adalah menggunakan volume perdagangan saham tahunan perusahaan yang terjadi pada tahun 2011-2015, sehingga mendapat suatu nilai yang dijadikan variabel dependen dalam penelitian ini.

2. Variabel Independen

Variabel independen adalah variabel yang memengaruhi variabel dependen, baik secara positif atau negatif. Terdapat tiga variabel independen dalam penelitian ini, yaitu:

a. Tingkat Inflasi (x_1)

Merupakan harga rata-rata dari semua harga dalam perekonomian. Perhitungan tingkat inflasi dipergunakan angka indeks harga konsumen (IHK) dalam satuan persen.

b. Suku bunga SBI (x_2)

Suku bunga SBI merupakan tingkat suku bunga yang ditentukan oleh Bank Indonesia atas penerbitan Sertifikat Bank Indonesia. Suku bunga SBI (tingkat suku bunga untuk 1 bulan) yang dikeluarkan oleh Bank Indonesia pada periode bulanan dalam satuan persen.

c. Nilai tukar (x_3)

Merupakan perbandingan harga antara mata uang dalam negeri yang diperlukan untuk mendapatkan satu unit mata uang asing yang diukur dengan nilai kurs tengah, dalam satuan rupiah.

C. Data Dan Sumber Data

Data dalam penelitian ini berisi data sekunder yaitu laporan tahunan perusahaan Agriculture yang tercatat di bursa efek Indonesia. Periode penelitian selama 2011-2015 dengan menggunakan data terbaru yang diperoleh dari situs internet www.idx.co.id, yaitu data laporan tahunan perusahaan Agriculture 2011-2015. Sumber data diperoleh dari Bank Indonesia (BI), Badan Pusat Statistik (BPS), PT. Agriculture.

D. Populasi Dan Sampel

Populasi yang digunakan sebagai sampel penelitian ini merupakan perusahaan- perusahaan pertanian dan perkebunan Agriculture, yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Kriteria yang digunakan untuk pengambilan sampel oleh peneliti sebagai berikut:

1. Saham perusahaan aktif diperdagangkan setiap bulan selama periode 2011-2015.
2. Tersedianya laporan perdagangan saham emiten setiap bulan selama periode 2011-2015
3. Data terdaftar di Bursa Efek Indonesia (BEI), dan dipublikasikan.

Berdasarkan kriteria tersebut terdapat dua belas perusahaan yang sesuai dengan kriteria sampel penelitian, yaitu AALI, BISI, BITEK, BWPT, GZCO, LSIP, PLAS, SGRO, TBLA, UNSP, WICO, BRAM.

E. Teknik Pengumpulan Data

Teknik pengumpulan data dalam penelitian ini menggunakan teknik dokumentasi, dengan mengumpulkan data-data yang diperlukan untuk melakukan analisis pada perusahaan yang telah terpilih sebagai sampel yaitu perusahaan pertanian dan perkebunan Agriculture yang tercatat pada Bursa Efek Indonesia (BEI), dalam penelitian ini data-data dikumpulkan dari situs internet www.idx.co.id, bursa efek Indonesia (BEI).

F. Teknik Analisis Data Dan Uji Hipotesis

Analisis dalam penelitian ini menggunakan analisis deskriptif. Teknik yang digunakan dalam menganalisis yaitu menggunakan program computer SPSS, adapun alat yang digunakan yaitu:

1. Analisis Regresi Linier Berganda

Bentuk-bentuk model regresi sederhana yang menunjukkan hubungan antara variabel, yaitu variabel X sebagai Variabel bebas dan variabel Y sebagai variabel tidak bebas sebagai berikut:

$$Y = a + b_1x_1 + b_2x_2 + b_3x_3$$

Dimana:

Y = volume perdagangan saham

a = konstanta

b_1 = tingkat inflasi

b_2 = suku bunga SBI

b_3 = nilai tukar

ϵ = variabel pengganggu / kesalahan penduga

2. Uji Hipotesis

a) Uji F (uji simultan)

Uji F atau uji simultan bertujuan untuk mengetahui apakah semua variabel bebas mempunyai pengaruh secara bersama-sama terhadap variabel terikat.

Hipotesis ini dirumuskan sebagai berikut:

$$H_0: \beta_1, \beta_2, \beta_3 = 0$$

Artinya proporsi variasi dalam variabel terikat yang dijelaskan bersama-sama oleh variabel bebas tidak signifikan.

$$H1: \beta_1, \beta_2, \beta_3 \neq 0$$

Artinya proporsi variasi dalam variabel terikat yang dijelaskan bersama-sama oleh variabel bebas signifikan.

b) Uji t (uji parsial)

Uji t atau uji parsial bertujuan untuk mengetahui seberapa jauh pengaruh variabel bebas secara individual dalam menjelaskan variabel terikat.

$$H0: \beta_1 = 0$$

Artinya bahwa tidak ada pengaruh nyata secara parsial antara variabel bebas terhadap volume perdagangan saham perusahaan yang terdaftar di BEI

$$H1 = \beta_1 \neq 0.$$

Artinya bahwa ada pengaruh nyata secara parsial antara variabel bebas terhadap volume perdagangan saham yang terdaftar di BEI.